

BBVAPC
FONDO BBVA MÉXICO DEUDA 11, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BACOMER	1602926		28,760.24	.00
CHD	BBVAES	2646035		33,030.89	.00
CHE	BBVAES	1538071		11,989.69	.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA					
AIM	BANDER	0048368		5,272,354.00	.65
TOTAL DISPONIBILIDADES				5,346,134.82	.66
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EXTRANJEROS (SPOT)					
56SP	BTAM2AU	LX	NA	69,960,097.14	8.60
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	BBVALIQ	F	AAA/1	466,869,826.75	57.40
51	BBVAMRF	F	AA/4	69,079,079.21	8.49
51	BBVARF	F	AA/2	196,315,835.35	24.14
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				802,224,838.45	98.63
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				802,224,838.45	98.63
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
M	BONOS	260903	mxAAA	6,620,692.50	.81
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				6,620,692.50	.81
OPERACIONES CON DERIVADOS					
FUTUROS					
FD	DEUA	MR25		-855,590.00	-.11
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					
				-855,590.00	
					-11
				TOTAL DE INVERSION EN VALORES	

CATEGORÍA

111

CALIFICACIÓN

AA/3 MO

VaR Promedio Mes

0.033627%

Límite de VaR

0.440%

Valor en Riesgo (VaR). El método de VaR utilizado es el histórico, para su cálculo se utilizan las matrices de escenarios proporcionadas por el Proveedor Oficial de Precios. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 13avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana

El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en el fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto.

